

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.08.2021

DISCRIMINAÇÃO	ESPÉCIE TIPO	QUANTIDADE	VALOR EM R\$	ALOCÇÃO DO PATRIMÔNIO (%)	DIVERSIFICAÇÃO (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.565.259.106,41		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			961.815.482,93	61,45	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOUREIRO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOUREIRO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		157.028	565.364.713,09	36,12	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			366.875.188,99	23,44	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		0,00	0,00	0,00	
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	13.141.991,09	0,84	0,84
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.403.988,49	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.047.692,08	0,13	0,35
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-13.141.991,09	-0,84	-0,84
- BANCO MORADA		-2	-5.451.680,57	-0,35	-0,35
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		1.708	160.785.700,34	10,27	
. BRADESCO		458	41.473.261,18	2,65	
. DAYCOVAL		500	24.856.389,80	1,59	
. SAFRA		90	41.183.368,89	2,63	
. PARANÁ BANCO		250,00	25.344.966,56	1,62	
. ABC		410,00	27.927.713,91	1,78	
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		40.114.433,99	206.089.488,65	13,17	
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP		30.166,67	2.799.900,63	0,18	0,18
. VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II		106.364,55	11.403.584,10	0,73	0,73
. KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM		30.680.789,24	42.717.922,27	2,73	2,73
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	14.101,55	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	6.845,71	0,00	0,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	24.323,58	0,00	0,00
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	766.311,81	0,05	0,05
. FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL		8.405,53	11.805.988,89	0,75	0,75
. BRAD RF DI FED EXTRA		6.767.822,21	83.769.152,59	5,35	5,35
. BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO		2.331.237,14	10.230.598,70	0,65	0,65
. VINCI VALOREM FIM		182.178,14	42.550.758,82	2,72	2,72
. VALORES A RECEBER				0,00	0,00
<u>Debêntures</u>		19.782	29.575.580,85	1,89	
. CEMIG		10.000	16.525.818,14	1,06	1,06
. ROTA DAS BANDEIRAS		8.792	10.480.697,19	0,67	0,67
. SABESP		990	2.569.065,52	0,16	0,16
. VALORES A RECEBER			3.127.765,40	0,20	
. COMANCHE PART.			3.127.765,40	0,20	0,20
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		0,00	-3.127.765,40	-0,20	
. COMANCHE PART.			-3.127.765,40	-0,20	-0,20
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			243.769.978,93	15,57	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			60.817.053,61	3,89	
<u>Companhias Abertas</u>		1.764.329	50.418.337,67	3,22	
. AMBEV	ON	87.539	1.496.916,90	0,10	
. ASSAI ATACADISTA	ON	213.000	3.580.530,00	0,23	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	64.254	1.504.828,68	0,10	
. COSAN	ON	194.400	4.286.520,00	0,27	
. ECORODOVIAS	ON	109.500	1.078.575,00	0,07	

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

. GERDAU - GGBR	PN	96.424	2.730.727,68	0,17
. ITAUSA	ON	216	2.505,60	0,00
. ITAUSA	PN	360.800	4.170.848,00	0,27
. LOGG COMERCIAL	ON	5.656	159.386,08	0,01
. MRVE	ON	78.400	1.073.296,00	0,07
. PÃO DE AÇUCAR	PN	42.600	1.206.858,00	0,08
. PETROBRÁS	PN	183.377	4.986.020,63	0,32
. RENT	ON	136.467	7.568.459,82	0,48
. SUZANO PAPEL	PNA	62.200	3.794.200,00	0,24
. VALE R. DOCE	PNA	129.496	12.778.665,28	0,82
Instituições Financeiras		384.828	10.358.183,39	0,66
. BRADESCO	PN	198.767	4.601.456,05	0,29
. ITAU	PN	186.061	5.756.727,34	0,37
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER (inst. Fin. + Companhia Aberta)			40.532,55	0,00
B2. Fundos		39.225.067,92	182.952.925,32	11,69
. VELT INST FICFIA		6.293.092,63	25.052.513,02	1,60
. CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA		11.421.519,84	39.470.883,21	2,52
. MOAT CAPITAL FIA		8.220.647,61	30.476.600,07	1,95
. SPX APACHE FIA		10.085.636,57	29.476.669,75	1,88
. BBM SMID CAPS FICFIA		3.096.544,16	27.691.011,52	1,77
. IBIUNA EQ. FIC FIA		62.732,91	22.075.021,85	1,41
. IBIUNA EQ. 30 FIC FIA		44.894,19	8.710.225,90	0,56
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		63.675.416,59	130.891.769,52	8,36
. INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II- FIP		10.858,75	-147.564,00	-0,01
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	6.188.682,29	0,40
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		9.354,00	8.965.345,45	0,57
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVPE PLAZA		2.000,00	1.801.224,22	0,12
. INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA		2.768.765,30	736.505,80	0,05
. FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE		763.123,24	1.139.172,86	0,07
. HAMILTON LANE FIC FIP		7.163,79	7.455.010,75	0,48
. STRATUS SCP BR FIP		5.000.000,00	9.039.215,00	0,58
. P2 BR INFRAESTRUTURA III FIC DE FIP		3.659,17	6.710.875,44	0,43
. COPA FLORESTAL III		10.000.000,00	1.031.004,40	0,07
. FIC DE FIM GARDE DUMAS		5.509.985,26	12.474.487,62	0,80
. KINEA CHRONOS FIM		11.925.565,78	22.157.778,74	1,42
. SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM		9.523.673,63	17.413.970,72	1,11
. BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM		18.077.115,65	20.721.060,12	1,32
. EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM		73.756,10	15.205.000,15	0,97
D-INVESTIMENTOS NO EXTERIOR		70.000.000	74.199.625,50	4,74
. SCHRODER PLAN II FIM		70.000.000,00	74.199.625,50	4,74
E-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			25.257.073,31	1,61
E1 - Investimentos em Shopping Center			20.608.987,04	1,32
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.523.184,20	1,31
. VALORES A RECEBER			85.802,84	0,01
E3 - Investimento Fundo Imobiliário		313,78	4.648.086,27	0,30
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		313,78	4.648.086,27	0,30
. VALORES A RECEBER				<u>0,00</u>
. VALORES A PAGAR				<u>0,00</u>
F - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.245	45.943.744,39	2,94
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.245	46.689.954,84	2,98
. VALORES A PAGAR (-)			-12.215,32	0,00
. VALORES A RECEBER			-733.995,13	-0,05

RESUMO DOS INVESTIMENTOS PREVIDENCIAL

PLANO II

G - OUTROS			83.381.431,83	5,33	
. DISPONIVEL			208.783,28	0,01	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			0,00	0,00	
. OUTROS REALIZAVEIS			72.229.230,60	4,61	
. OUTROS DIREITOS A RECEBER			83.814.169,50	5,35	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-641.520,95	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-72.229.230,60	-4,61	

GESTÃO TERCEIRIZADA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO TERCEIRIZADA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
FUNDOS					
- VELT INST FICFIA			25.052.513,02	4,18%	1,60%
- CONSTELLATION INSTITUCIONAL FIC FIA			39.470.883,21	6,59%	2,52%
- IBIUNA EQ. 30 FIC FIA			8.710.225,90	1,45%	0,56%
- MOAT CAPITAL FIA			30.476.600,07	5,09%	1,95%
- BBM SMID CAPS FICFIA			27.691.011,52	4,62%	1,77%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP			2.799.900,63	0,47%	0,18%
- VINCI FI RF IMOBILIÁRIO CP II			11.403.584,10	1,90%	0,73%
- IBIUNA EQ. FIC FIA			22.075.021,85	3,69%	1,41%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER			14.101,55	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II			6.845,71	0,00%	0,00%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III			24.323,58	0,00%	0,00%
- SPX APACHE FIA			29.476.669,75	4,92%	1,88%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.			766.311,81	0,13%	0,05%
- FIDC - VINCI ENERGIA SUSTENTÁVEL			11.805.988,89	1,97%	0,75%
- KINEA IPCA ABSOLUTO FIC FI DE FIM			42.717.922,27	7,13%	2,73%
- BRAD RF DI FED EXTRA			83.769.152,59	13,99%	5,35%
- BB INSTITUCIONAL FEDERAL FIC RENDA FIXA LONGO PRAZO			10.230.598,70	1,71%	0,65%
- VINCI VALOREM FIM			42.550.758,82	7,11%	2,72%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					
- INVESTIDORES INSTITUCIONAIS II - FIP			(147.564,00)	-0,02%	-0,01%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES			6.188.682,29	1,03%	0,40%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP			8.965.345,45	1,50%	0,57%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA			1.801.224,22	0,30%	0,12%
- INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA			736.505,80	0,12%	0,05%
- FIP INSEED FUNDO DE INOVAÇÃO EM MEIO AMBIENTE			1.139.172,86	0,19%	0,07%
- HAMILTON LANE FIC FIP			7.455.010,75	1,25%	0,48%
- STRATUS SCP BR FIP			9.039.215,00	1,51%	0,58%
- P2BR INFR III FIQFIP			6.710.875,44	1,12%	0,43%
- COPA FLORESTAL III			1.031.004,40	0,17%	0,07%
- FIC DE FIM GARDE DUMAS			12.474.487,62	2,08%	0,80%
- KINEA CHRONOS FIM			22.157.778,74	3,70%	1,42%
- SPX NIMITZ ESTRUTURADO FIC DE FIM			17.413.970,72	2,91%	1,11%
- BAHIA AM MARAU ESTRUTURADO FIC DE FIM			20.721.060,12	3,46%	1,32%
- EXPLORITAS ALPHA AMERICA LATINA FIC DE FIM			15.205.000,15	2,54%	0,97%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS					
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO			4.648.086,27	0,78%	0,30%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR					
- SCHRODER PLAN II FIM			74.199.625,50	12,39%	4,74%
TOTAL			598.781.895,26	100,00%	38,25%

GESTÃO PRÓPRIA			DISTRIBUIÇÃO	% EM RELAÇÃO À GESTÃO PRÓPRIA	% EM RELAÇÃO AOS RECURSOS GARANTIDORES
RENTA FIXA			755.725.994,28	78,19%	48,28%
RENTA VARIÁVEL			60.817.053,61	6,29%	3,89%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			20.608.987,04	2,13%	1,32%
EMPRÉSTIMO PESSOAL			45.943.744,39	4,75%	2,94%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)			83.381.431,83	8,63%	5,33%
TOTAL			966.477.211,15	100,00%	61,75%